

円連日の年初来高値

一時、81円73銭まで上昇

午前の東京外為市場のドル・円相場は、円が81円台後半の高値圏で推移。円は一時81円73銭まで上昇し、前日に付けた東京市場の年初来高値を更新。95年4月26日の81円15銭以来、約15年6カ月ぶりの円高水準を付けた。その後は、本邦当局による介入警戒感や輸入企業などのドル買いが観測され、円は82円ちょうど付近まで戻される場面もあった。9月21日のFOMC議事録では、多数派に近い将来の追加の量的緩和の必要性を主張していたことが確認され、次回11月3日のFOMCでの緩和の可能性が一段と高まり、ドル安に影響したとみられる。ただ、米金利が上昇しているため、ドル売りへの突っ込み警戒感もあり、円の伸び悩みにつながっている。一方、ユーロ相場は、前日の調整が一巡し、対ドルは1・39ドル台後半、対円は114円台前半に強含んでいる。



Finance Facsimile News

金融ファクシミリ新聞

2010年(平成22年)第5277号
(無断コピーおよび転送は固くお断りします) 10月13日(水)

◆長国保有額55兆6634億円 (U)
日銀は13日午前、10月10日現在の営業毎旬報告を発表。それによると、資産合計は117兆1479億円と、9月30日現在に比べて3兆9054億円減少した。うち、国債の保有総額は76兆5672億円、同1014億円減少。内訳は長期国債55兆6634億円(同1319億円増加)、短期国債20兆9037億円(同2334億円減少)で、ちなみに発行銀行券は76兆6565億円。一方、金銭の信託(信託財産株式)は、1兆5065億円で、同変わらず。なお、共通担保資金供給オペ及び成長基盤強化を支援するための資金供給による貸付金は、32兆3034億円で、同3兆8008億円減少。(W)

◆ベスト電器が急伸 ▲
前場の株式市場では、ベスト電器(8175)が急伸。一時、前日比20円高の220円まで買われ、東証1部の値上がり率2位となった。前日、11年2月期通期の業績予想を上方修正したことが材料。株価は低位で手掛けやすく、目先筋の買いを集めた。一方、ティール・エヌ・エー(2432)が急落。前日、米国のスマートフォン向けソーシャルゲームアプリ開発会社を買収すると発表した。買収対価として新株と新株予約権を発行するため、希薄化が懸念された。このほか、業績下方修正の東京製鉄(5423)が大幅安。(V)

▲平均株価は底堅い動き ▲
平均株価は底堅い動き。米株価が堅調な足どりと重なったことに加え、機械受注統計が大幅なプラスとなったことも追い風となり、買い戻しの動きが強まった。また、前日まで下げ3日で、値下がり銘柄数が9割を超えたことなど、テクニカル面での突っ込み警戒感が台頭していたことも底堅い動きにつながった模様。ハイテクなど主軸の輸出関連のほか、不

動産や商社、金融の一角など、内需関連にも幅広く買いが波及している。平均株価は前場、一時9510円まで上昇した。東証1部の騰落銘柄数は、値上がり980、値下がりが455。TOPIXは826・175832・86ポイントの動き。東証1部出来高は8億1538万株。(J)

◆国債先物は小反落商状◆

長期国債先物相場は小反落商状。米債の軟化と株価堅調地合いに加え、機械受注が大方の予想に反してプラスとなったことが嫌気され、やや高値警戒感もあったことで、朝方から売りが優勢となった。ただ、低金利政策の長期化観測を背景にした押し目買いの動きに、中期ゾーンが底堅い動きとなったことで、下げ幅も限定的となった。先物12月限は前場、一時144円05銭まで上昇した後、143円78銭まで下落する場面があった。出来高は1兆5584億円。一方、業者間取引(BB)の現物債では、指標の10年311回債で0・860%、0・890%の動き。5年91回債は0・225%、0・240%、20年121回債は1・685%、1・735%、30年33回債は1・880%、1・950%の各出合いが見られている。(W)

※円金利スワップは払い先行 ※

午前の円金利スワップは固定金利払いが先行。債券市場の重め感を受けて小幅金利上昇している。10年の気配は0・99875%、89875%。(E)

◎円金先は一進一退 ◎

ユーロ円金先は、閑散商状のなか横ばい圏。午前11時5分現在、中心限月11年6月限は、99・715、99・725の動き。出来高概算は2800枚。一方、期近の12月限は99・680、99・685の動きで出来高わずか68枚。(W)

●足元金利は落ち着き ●

午前の無担保翌日物は0・08%前後の取引。積み最終日が近づいているものの、総じて落ち着いている。短期市場は入札を控えて様子見。日銀は午前ノオオペ。きょうの当預残は16兆9000億円程度、準預残は13兆1000億円程度の見込み。(E)

◆包括緩和の規模拡大は有力な選択肢◆

衆院予算委で白川総裁

衆議院予算委員会では13日、白川総裁が日銀の包括緩和について「今回作った基金は大きな効果を期待している」と述べ、「将来必要なきには規模をさらに拡大して活用していくことも有力な選択肢の一つ」との考えを明らかにした。また、菅首相は為替市場の動向に言及し、韓国・中国が自国通貨を意図的に安いレートに誘導していることは好ましくないとの認識を示したうえで、両国に対して「共通ルールの中で責任のある行動をとって頂きたい」とした。このほか、法人税率については課税ベース拡大も含めて、税調などで引き下げの方向で検討するとしたものの、「数字は明らかにできる状況ではない」とコメントした。(K)

2010.10.13 午前11時現在		
ドル/円	81.90	▼0.02
ユーロ/円	114.32	△1.16
平均株価	9469.47	△80.83
TOPIX	830.20	△5.60
225先 ⁽¹⁾	9460	△60
TOPIX先 ⁽¹⁾	829.0	△3.5
国内CB単平	101.36	+0.03
債券先物 ⁽²⁾	143.91円	-0.15円
311回債	0.885%	+0.035%
310回債	0.855%	+0.020%
309回債	0.835%	+0.035%
5年91回債	0.235%	+0.010%
2年297回債	0.120%	-
超長期121回	1.735%	+0.055%
円・円スワップ	気配(%)	
2年	0.43	~ 0.33
3年	0.43625	~ 0.33625
5年	0.50375	~ 0.40375
10年	0.99875	~ 0.89875
無担保翌日物	0.085%	程度
ユーロ円現物金利		
1か月	0.13%	~ 0.06%
2か月	0.14%	~ 0.07%
3か月	0.16%	~ 0.09%
短期142回債		
ユーロ円金先 ⁽³⁾	99.720	±0
日銀当座預金増減要因と金融調節(単位:億円)		
12日	実績	
当座預金増減	+4100	
当座預金残高	170000	

※無担保翌日物は中心、比較は前営業日
現物国債は前場BB出来値

無断コピーおよび転送は固くお断りしております

機械受注が3カ月連続の増加

8月の前月比は10・1%増

内閣府が発表した8月の機械受注（船舶・電力除く民需季調済み）は、前月比10・1%増と3カ月連続の増加。増加率は昨年12月の15・4%増以来、8カ月ぶりの大きさ。3カ月連続の増加は、05年10～12月以来、4年8カ月ぶりのこと。8月の内訳を見ると、製造業が同12・5%増（3カ月連続の増加）、非製造業が同8・3%増（2カ月連続の増加）。製造業で増加した業種は、電気機械、非鉄金属、鉄鋼業など。また、非製造業で増加した業種は、その他非製造業、運輸業などで、いくつかの業種で大型案件があった。一方、7～9月の当初見通しである前期比0・8%増を達成するためには、9月の前月比が32・9%減でも達成可能。9月の前月比ゼロ%でも7～9月の前期比は13・6%増となる。内閣府は基調判断について、大型案件を除いても増加し、「持ち直している」に上方修正した。(U)

増加率が3カ月連続の2.1%

9月のマネーストックのM3

日銀が発表した9月末のマネーストック速報によると、現金・預金、準通貨、CD（譲渡性預金）で構成されるM3は、前年同月比2・1%増の1079兆1000億円だった。伸びは3カ月連続で変わらず、2%台の伸びが14カ月連続で続いている。預金通貨の伸び率が同2・5%増に拡大（06年8月の同2・5%増に並ぶ、4年1カ月ぶりの高水準）し、M1は同2・4%増と3カ月連続で拡大。増加率は06年8月の同2・4%増に並び、4年1カ月ぶりの高水準。また、CDは同28・6%増（02年1月の同28・8%増以来、8年8カ月ぶりの高い伸び）で増加率は拡大。ただ、定期預金を含む準通貨の伸びが同0・7%増と11カ月連続で縮小したため、M3の伸びは変わらず。定期預金より金利が高いCDに資金が向かい、準通貨が鈍化しているが、法人を中心に手元資金を潤沢にする動きは続いている。一方、広義流動性は同0・5%増で、伸び率は7月と変わらず。授信や国債が減少した。(U)

都銀貸出なお伸び悩み

9月の貸出・資金吸収動向

日銀が午前に発表した9月の貸出・資金吸収動向等によると、9月の銀行計の貸出は総貸出平残前年比で1・8%減となった。減少幅は前月（2・0%減）から縮小した。個別では、都銀等が平残前年比で3・9%減（前月4・0%減）、地銀が同0・6%増（同0・4%増）、第二地銀が同0・6%減（同0・8%減）だった。都銀の減少幅は前月比で小幅縮小したものの、資金需要の低迷から伸び悩みが続いている。また、銀行・信金計は同1・8%減（同1・9%減）。特殊要因調整後では、銀行計が前年比1・6%減（前月1・7%減）、うち都銀等が同3・7%減（同3・8%減）、地銀が同0・9%増（同0・7%増）、第二地銀が同0・2%減（同0・4%減）だった。

CP発行残高は前月比大幅減

CP発行状況では、9月末時点の銀行等引受分末残は9兆2456億円、前月比8161億円の減少となった。前年同月比では9・6%の減少。一方、銀行等発行分末残は8176億円、前月比302億円の増加だった。(E)

10年9月の貸出・資金吸収動向等(速報)

1. 貸出動向	2010年		2010年			9月平残
	4-6月	7-9月	7月	8月	9月	
銀行・信金計	▲1.9	▲1.8	▲1.8	▲1.9	▲1.8	4,568,489
銀行系	▲2.0	▲1.9	▲1.9	▲2.0	▲1.8	3,942,741
都銀等	▲3.8	▲3.8	▲3.7	r▲4.0	▲3.9	2,003,760
地銀・地銀Ⅱ	▲0.1	0.2	0.0	0.2	0.4	1,938,981
地銀	0.0	0.4	0.2	r0.4	0.6	1,513,662
地銀Ⅱ	▲0.4	▲0.7	▲0.7	▲0.8	▲0.6	425,319
信金	▲1.4	▲1.4	▲1.4	r▲1.4	▲1.3	625,748
外銀(参考)	▲14.0	▲16.1	▲16.9	▲18.3	▲12.9	38,833

(注1)外銀は円貸出
(注2)信金は信金中央金庫調べ
(注3)「その他国内対象銀行」の2010年3月平残計数は24,369億円(同計数は、上記銀行計に含まれない)

2. CP発行状況	2010年		2010年		
	4-6月	7-9月	7月	8月	9月
銀行等引受分末残	97,608	92,456	105,940	100,617	92,456
(前年比)	(▲20.4)	(▲9.6)	(▲11.7)	(▲14.0)	(▲9.6)
銀行等発行分末残	8,057	8,176	8,273	7,874	8,176

出所:日銀

【国内SBシェア】

- ★前田建設工業第17回債 発行額100億円 ☆大和証券キャピタル・マーケット55% ☆みずほ45% 以上2社
- ★富士通第26回債 発行額200億円 ☆大和証券キャピタル・マーケット50% ☆みずほ、野村各20% ☆UBS10% 以上4社
- ★富士通第27回債 発行額300億円 ☆みずほ66.67% ☆日興コーディアル16.67% ☆大和証券キャピタル・マーケット10% ☆三菱UFJモルガン・スタンレー6.67% 以上4社

富士通2本立て債などが条件決定

▼富士通(6702) 第26回債①発行額200億円②主幹事大和証券CM(事務)、みずほ、野村、UBS③期間3年(償還日13年10月18日)④利率0・307%⑤スプレッドJGB第254回債プラス16bp⑥発行価格100円⑦募集13日⑧払込日20日⑨発行・支払・財務代理人三井住友銀⑩格付けAプラス(R&I) ⑪手数料幹事(5銭)、引受(5銭)、販売(17・5銭) ⑫各社債の金額1億円⑬利払日4月と10月の各20日▼同(6702) 第27回債①300億円②みずほ(事務) 大和証券CM、日興Co、三菱UFJMS③5年(15年10月20日)④0・42%⑤JGB第272回債プラス18bp⑥同⑦同⑧同⑨みずほC銀⑩同⑪幹事(1000万円)、引受(5銭)、販売(24銭) ⑫同⑬同▼前田建設工業(1824) 第17回債①100億円②大和証券CM(事務)、みずほ③3年(13年10月18日)④1・79%⑤Lプラス135bp⑥100円⑦13日⑧19日⑨三菱東京UFJ銀⑩Aa3(MDY)、Aプラス(S&P)、AAMイナス(フィッチ) ⑪⑫1億円⑬4月と10月の各19日▼同第5回債(2010) ①211億円②RBS、三菱UFJMS、みずほ③5年(15年10月19日)④2・15%⑤Lプラス165bp⑥同⑦同⑧同⑨同⑩同⑪同⑫同⑬同▼変動利付円貨社債第2回債(2010) ①51億円②RBS、三菱UFJMS、みずほ③3年(13年10月18日)④3カ月LIBORプラス1・50%⑤⑥同⑦同⑧同⑨同⑩同⑪同⑫同⑬同

※神戸市10年債がマーケティングを継続

神戸市10年債がマーケティングを継続。マーケティングレンジは第311回10年国債プラス6bp、6・5bp。発行額は100億円程度、条件決定は15日を予定。(F)

(2)

(2)